

Макроэконометрика

Преподаватель: к.э.н. Пестова Анна Андреевна, ЦМАКП.

Цель освоения дисциплины:

ознакомить слушателей с современным эконометрическим инструментарием моделирования макроэкономической динамики и дать практические навыки моделирования.

Краткое содержание дисциплины:

- ❖ Структурные модели макроэкономического прогнозирования.
- ❖ Эволюция макроэкономической теории и практико-ориентированных теоретических моделей.
- ❖ Одномерные модели: оценка и прогнозирование.
- ❖ Многомерные модели временных рядов: VAR.
- ❖ Многомерные модели временных рядов: байесовские VAR.
- ❖ Основы байесовской эконометрики.
- ❖ Условный прогноз.
- ❖ Многомерные модели временных рядов: факторные модели.
- ❖ Структурные модели временных рядов: шоки и фрикции в макроэкономических колебаниях; идентификация шоков политики, способы и ограничения; анализ импульсных функций отклика, разложение вариации и историческая декомпозиция.
- ❖ Сбор статистических данных для исследования: что, где, когда.

Общая трудоемкость дисциплины составляет: 3 зачетные единицы, 108 часов.

Итоговый контроль по дисциплине проводится в форме экзамена.